

流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項(2023年3月期第3四半期)

【三井住友信託銀行】

(連結・国際統一基準)

(単位:百万円、%、件)

項目	当四半期		前四半期		
適格流動資産 (1)					
1	適格流動資産の合計額		19,347,711	19,092,731	
資金流出額 (2)					
	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	資金流出率を乗じる前の額	資金流出率を乗じた後の額	
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	19,051,934	914,814	19,123,412	918,595
3	うち、安定預金の額	1,788,463	53,653	1,807,223	54,216
4	うち、準安定預金の額	8,608,609	861,160	8,640,725	864,378
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	14,728,175	11,569,713	14,725,218	11,487,331
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	—	—	—	—
7	うち、適格オペレーショナル預金及び負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	11,443,112	8,284,651	11,045,668	7,807,780
8	うち、負債性有価証券の額	3,285,062	3,285,062	3,679,550	3,679,550
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		702		15,361
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	7,480,551	2,583,495	7,135,435	2,406,008
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	1,237,270	1,237,270	1,064,895	1,064,895
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	—	—	—	—
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	6,243,280	1,346,224	6,070,540	1,341,113
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	236,298	164,432	214,862	158,152
15	偶発事象に係る資金流出額	662,611	17,706	657,359	17,623
16	資金流出合計額		15,250,865		15,003,072
資金流入額 (3)					
	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	資金流入率を乗じる前の額	資金流入率を乗じた後の額	
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	230,742	—	282,589	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	2,526,458	1,704,190	2,593,151	1,719,007
19	その他資金流入額	554,542	438,073	745,888	452,116
20	資金流入合計額	3,311,743	2,142,263	3,621,629	2,171,124
連結流動性カバレッジ比率 (4)					
21	算入可能適格流動資産の合計額		19,347,711	19,092,731	
22	純資金流出額		13,108,601	12,831,948	
23	連結流動性カバレッジ比率		147.5	148.7	
24	平均値計算用データ数		62	62	